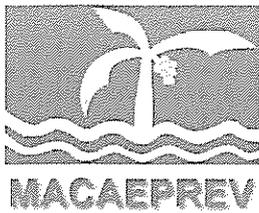




Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social
Conselho Previdenciário

ATA nº 020/2016 de 18/10/2016 – Ata de Reunião do Conselho Previdenciário do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé – Macaeprev, inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, na Rua Visconde de Quissamã, setecentos e oitenta e sete, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, do dia dezoito de outubro de dois mil e dezesseis, estando presentes os membros **Julio Cesar Marques de Carvalho, Patric Alves de Vasconcellos, Junir de Miranda Gomes, Livia Mussi de Oliveira Sant'Ana, Neiva dos Santos, Surama Roberto Soutinho de Oliveira, Alexander Ferreira Gonçalves, Juciara da Silva Sobrinho de Oliveira**, e o presidente do Macaeprev **Rodolfo Tanus Madeira**, para em conjunto analisarem e deliberarem sobre os temas apresentados. Presentes também, os membros do Comitê de Investimentos **Augusto Rômulo Fauaz de Andrade e José Eduardo da Silva Guinâncio**. Aberta a reunião, foram justificadas as ausências dos membros *Flávio Mancebo de Azevedo e Rui de Vasconcellos*, estando devidamente representados por seus suplentes. Passada a palavra ao administrador do fundo, Sr. **Augusto Rômulo** prestou os seguintes esclarecimentos acerca da Carteira do Macaeprev: que apresentou no mês de setembro de 2016 melhoras em relação a agosto, já que sua média ponderada ficou em +1,28% e superou a meta atuarial de setembro, que ficou em +0,57%. Em relação ao desempenho da carteira no acumulado do ano (janeiro a setembro), apresentou média ponderada de +13,62%, enquanto a meta atuarial acumulada ficou em +10,23%. Com isso, a carteira do Instituto superou em +33,15% a meta atuarial, para o exercício de 2016 até esse período. A melhor aplicação no ano de 2016, continuou sendo o fundo de renda variável Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo FI, com rentabilidade acumulada no ano de +28,10%. Em seguida veio o fundo de renda fixa BB PREVID. RF IMA-B TP, cujo benchmark é o IMA-B, com +21,80%. No mês de setembro, com a queda da inflação, medida pelo IBGE, através do IPCA, a não alteração da Taxa de Juros Americana, pelo FED e a Taxa Selic, pelo COPOM, foram vetores determinantes para que os fundos de renda fixa, sem carência, da carteira, atrelados ao IRF-M, tivessem a melhor rentabilidade no mês, com uma rentabilidade média de +1,95%, superando com facilidade a meta atuarial. Também vale destacar o bom desempenho dos fundos atrelados ao IMA-GERAL e IMA-B, que obtiveram rentabilidades médias respectivas de: +1,70% e +1,55%, também superando com larga margem a meta atuarial. Com relação aos fundos de renda fixa, sem carência da carteira, cujos *benchmarks*, são IMA-B5 e IDKA 2A, também conseguiram superar a meta atuarial, com as rentabilidades médias respectivas de: +1,39 e +1,33%. Em relação aos fundos de renda fixa, sem carência, mais conservadores, atrelados ao IRF-M1 e ao DI, também superaram a meta atuarial de setembro, com rentabilidades médias respectivas de: +1,16% e +1,06%. Falando do fundo de renda variável ativo do Banco Itaú, atrelado ao IBOVESPA, este apresentou a pior rentabilidade do mês, com a rentabilidade negativa de 0,22%. Mesmo assim ainda é a melhor rentabilidade da carteira no ano de 2016. Em relação aos fundos de renda fixa com carência, da CEF, cuja carteira é composta por NTN-B, todos eles



Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social
Conselho Previdenciário

superaram a meta atuarial conforme descrição abaixo: 1) Marcação na curva com vencimentos em 2018, 2020 e 2022, apresentaram rentabilidades respectivas de: +0,80%, +0,80% e +0,79%. 2) Marcação à mercado como os fundos 2018II, 2020IV e 2024IV, também superaram a meta atuarial, com as rentabilidades respectivas de: +1,34%, +1,46% e +1,13%. Já os fundos de renda fixa, com carência, do Banco do Brasil, como os fundos BB PREVID. RF VIII TP, formado por LTN e BB PREVID. RF TP XII FI, composto por NTN-B, superaram a meta atuarial e tiveram as rentabilidades respectivas de: +1,14% e +1,34%. Em relação ao resultado, dos rendimentos no mês de setembro, o saldo mais uma vez, foi positivo, ficando em R\$ 24.413.133,47 (vinte e quatro milhões, quatrocentos e treze mil, cento e trinta e três reais e quarenta e sete centavos), sem o pagamento do cupom de juros. Em relação ao FIDC Multisetorial Itália, apresentou rentabilidade positiva, em setembro de +0,87%, superando a meta atuarial. Nos últimos 12 meses, apresentou rendimento acumulado de +22,68%. Em relação a esse fundo já foram resgatados até o final de setembro, cerca de R\$ 5.874.000,00 (cinco milhões, oitocentos e setenta e quatro mil reais), correspondendo a 58,74%. Em relação à classificação, referente a rentabilidade média acumulada dos últimos 12 meses (out/15 a set/16), por benchmark, dos fundos de renda fixa e variável da carteira do Macaeprev, sem carência ficou assim: 1º IMA-B com +27,68%, 2º IBOVESPA ATIVO com +25,10%, 3º IMA GERAL com +22,43%, 4º IRF-M com +21,96%, 5º IMA-B5 com +18,49%, 6º IDKA2A com +18,28%, 7º IRFM-1 com +14,95%, 8º DI com +13,47%. Em relação à composição da carteira por classificação de risco, ficou assim no mês de setembro/16: Baixo Risco 65,04%, Médio Risco 23,50% e 11,46% de alto risco. Existe em 30/09/2016, cerca de R\$ 204.491.000,00 (duzentos e quatro milhões e quatrocentos e noventa e um mil reais), aplicados em fundos, que tem como benchmark, o IMA-B, representando 10,57% da carteira, contra 65,04% de fundos de renda fixa conservadores. Com relação à alocação de recursos por Instituições Financeiras em setembro/16, a carteira do Macaeprev ficou composta da seguinte maneira: Caixa Econômica Federal 52,86%, Banco do Brasil 35,24%, Itaú 6,58%, Bradesco 5,16% e BRL TRUST DTVM 0,16%. Com isso os recursos alocados em Bancos Oficiais Públicos são de + 88,10% e Instituições Privadas + 11,90%. Com relação à alocação de recursos por índices de referência: Marcação na curva e a mercado com carência, com vértice do BB e CEF: 47,51%, sem carência: IRFM1: 6,05%, IMA-B: 10,57%, IRF-M: 4,62%, IMA GERAL: 5,16%, DI: 5,87%, IMA-B5: 6,96%, IDKA2A: 12,37% e IBOVESPA ATIVO 0,73% e com carência sem vértice: FIDC FECHADO 0,16%. O total das despesas previdenciárias, em setembro ficou em R\$ 3.369.686,21 (três milhões, trezentos e sessenta e nove mil, seiscentos e oitenta e seis reais e vinte e um centavos). A despesa com o auxílio doença em setembro foi de R\$ 967.824,78 (novecentos e sessenta e sete mil, oitocentos e vinte e quatro reais e setenta e oito centavos), representando com isso 28,72% das despesas previdenciárias. O Patrimônio Líquido do Macaeprev em 30/09/16 apresentou, mais uma vez, crescimento, fechando o mês em R\$ 1.933.889.925,35 (um bilhão, novecentos e trinta e três

Bautista
2
Aparecida



Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social
Conselho Previdenciário

milhões, oitocentos e oitenta e nove mil, novecentos e vinte e cinco reais e trinta e cinco centavos), continuando com boa probabilidade de atingir R\$ 2.000.000.000,00 (dois bilhões de reais) ao final do exercício de 2016, o que comprovaria efetivamente o acerto na alocação dos recursos, aliado a uma boa proteção da carteira. Fica a próxima reunião designada para o próximo dia oito, com vistas à apresentação do cálculo atuarial. Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada, tendo a ata sido lida e assinada por todos os membros presentes.

Membros:


Julio César Marques de Carvalho


Patric Alves de Vasconcelos


Lívia Mussi de Oliveira Sant'Ana


Juciara da Silva Sobrinho de Oliveira


Alexander Ferreira Gonçalves

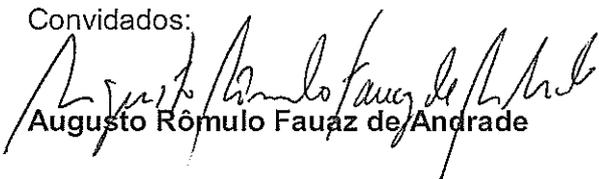

Neiva dos Santos


Junir de Miranda Gomes


Surama Roberto Soutinho de Oliveira

Rodolfo Tanus Madeira

Convidados:


Augusto Rômulo Fauaz de Andrade


José Eduardo da Silva Guinâncio

100